

# 廷豐金融科技 AI投資策略

- 台股強勢動能策略  
-SNI機制成功避開市場大跌

2025 年 04 月 10 日



## 以避險基金核心宗旨為依歸，主動規避風險，創造絕對報酬

避險基金的濫觴乃是利用衍生性金融商品進行避險操作，如今避險基金已發展出靈活運用多樣化策略以捕捉不同市場或商品間的機會、透過多空策略或衍生性金融商品操作減少市場波動對投資組合的影響、追求在任何市場環境下獲得穩定的絕對收益等核心宗旨。

廷豐金融科技開發之台股強勢動能策略以避險基金核心宗旨為依歸，透過自動化機制主動規避市場風險，取得絕對報酬，並在市場大幅震盪時期盡顯其價值。

## 下檔保護系統-SNI機制-精準判斷大跌風險，多次化危機為轉機

SNI (Safety Net Indicator, 安全網指標) 機制為台股強勢動能策略之下檔保護系統，亦為策略的多項關鍵技術之一，其能夠藉由自動化衡量市場主力動向、位階高低、波動幅度，精準判斷台股潛在下檔風險，進一步做投資組合的多空自動調整(清倉個股多單部位，並以兩成資金買進放空型ETF)。

2025年初台股創高後，隨川普就任，相關中美關稅戰持續影響市場，下行風險逐步攀高，2025年4月1日觸發SNI機制並即時進行多空調整，不僅即時避開2025年4月7日至9日的台股重挫，更確保投組報酬保持穩健上行，使今年以來策略累計報酬贏過大盤15%，更顯著優於其他同類型基金。

2025年初至今策略與大盤績效比較



無獨有偶，往前回溯近一年情況，2024年7月中旬台股創高後，下行風險逐步攀高，SNI持續起到關鍵作用，即時避開兩次台股重挫(2024年8月上旬受日元平倉交易引發大跌、9月上旬因美國關鍵數據疲軟重挫)。

2024年第三季策略與大盤績效比較



## 台股強勢動能策略簡介

以上市、櫃公司為投資標的，主軸基於掌握台股投資機會，建立籌碼主力鎖定、技術面強勢、業績成長支撐，具規模、流動性佳之投資組合。

**強勢動能策略已取得台灣新型專利(新型第M661735號)，有效期為2024年10月至2034年7月。**

- 籌碼主力鎖定
- 技術面強勢
- 業績成長支撐
- 智慧持強汰弱
- 程式自動交易
- 鎖報酬降風險

交易商品：台股  
交易時間：全時段實時交易  
交易模式：全自動多空程式交易  
淨值呈現期間：  
2014/06/03~2025/04/09 (回測)  
交易成本：手續費千分之1.425、證券交易稅千分之3

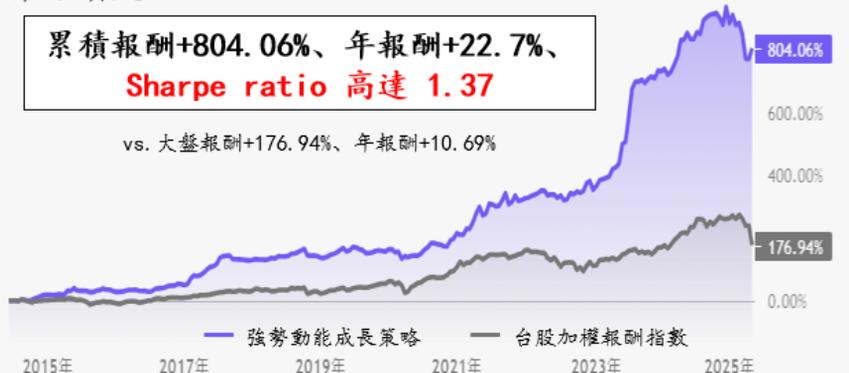
累積總報酬率 <b>+804.06%</b>	年報酬率 <b>+22.7%</b>	勝率 <b>48.1%</b>
最大回撤MDD <b>-19.8%</b>	夏普比率 <b>1.37</b>	MDD平均回復天數 <b>32.1天</b>

### 策略績效

最後更新日期：2025/04/09

**累積報酬+804.06%、年報酬+22.7%、  
Sharpe ratio 高達 1.37**

vs. 大盤報酬+176.94%、年報酬+10.69%



**過去 10 年，每年均能帶來正報酬！**

年報酬	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
策略	40%	10%	15%	55%	3%	11%	19%	38%	7%	82%	20%
大盤	4%	-7%	16%	20%	-5%	29%	27%	28%	-19%	32%	32%

## 績效表現(%)

### 策略與大盤及國內投資股票型基金平均績效比較

	近一週 績效(%)	排名	近一月 績效(%)	排名	近三月 績效(%)	排名	近六月 績效(%)	排名	今年以來 績效(%)	排名	近一年 績效(%)	排名	近三年 績效(%)	排名	近十年 績效(%)	排名*
台股強勢動能策略	<b>3.73</b>	<b>1/143</b>	<b>-4.27</b>	<b>1/143</b>	<b>-9.07</b>	<b>1/143</b>	<b>-9.61</b>	<b>1/143</b>	<b>-8.13</b>	<b>1/143</b>	<b>-1.94</b>	<b>1/141</b>	<b>103.06</b>	<b>1/134</b>	<b>579.98</b>	<b>1/122</b>
大盤加權報酬(還原)績效	-15.96	-	-22.38	-	-24.27	-	-21.66	-	-23.65	-	-11.63	-	9.55	-	170.76	-
國內投資股票型基金平均績效	-20.78	-	-27.67	-	-31.42	-	-29.75	-	-32.29	-	-27.87	-	-1.89	-	140.95	-

\*資料截至2025/04/09

獨家多空濾網掌握大盤動向，靈活切換多空策略交易，提高整體交易績效和準確性，為空頭熊市積極操作多空，達成抗跌避險的效益；

### 策略相較大盤之年報酬情況(空頭年)

2015中國大股災

2018中美貿易戰

2022美國急升息

0050 元大台灣卓越50基金

台股加權報酬指數

台股強勢動能策略



---

此報告內容由廷豐金融科技股份有限公司（下稱「廷豐金融科技」）編製，所提供之內容及數據僅供參考用途，如有任何更改，恕不另行通知。該內容及數據包括但不限於聲明、評論、意見、建議，圖表影像，新聞及研究報告(下稱「資料」)，均屬於廷豐金融科技之財產，未經廷豐金融科技之事先書面同意，均不得以任何方式及任何形式複製、複印、出版、披露、發放、傳送或引用給任何其他人。

廷豐金融科技皆致力保證所提供內容與資料之準確性及可靠性，但不擔保資訊內容之正確性、即時性、完整性或可靠性。廷豐金融科技在任何情況下均不會承擔因數據不準確、錯誤、延誤或遺漏而導致損失或造成破壞之責任(包括民事侵權行為責任、合約責任或任何其他責任)。

本文所有資料內容不代表任何形式之推介、要約、承諾、勸誘或保證，亦不應被解讀為投資建議。

閣下作出任何投資決定時，應自行衡量風險，若閣下有任何疑問，應諮詢其他專業人士意見。

廷豐金融科技不會對任何人士和或第三方因使用任何本公司提供之資料或服務而產生的直接、間接、相應或附帶的任何類型的損失承擔責任。

---